

融通巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 月 30 日

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2016 年 10 月 26 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 10 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 7 月 1 日起至 2016 年 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	融通巨潮 100 指数 (LOF)
场内简称	融通巨潮
交易代码	161607
前端交易代码	161607
后端交易代码	161657
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 5 月 12 日
报告期末基金份额总额	797,213,964.22 份
投资目标	本基金为增强型指数基金。在控制股票投资组合相对巨潮 100 目标指数跟踪误差的基础上，力求获得超越巨潮 100 目标指数的投资收益，追求长期的资本增值。本基金谋求分享中国经济的持续、稳定增长和中国证券市场发展的成果，实现基金财产的长期增长，为投资者带来稳定的回报。
投资策略	本基金为增强型指数基金，在控制股票投资组合相对目标指数偏离风险的基础上，力争获得超越目标指数的投资收益。基金以指数化分散投资为主要投资策略，在此基础上进行适度的主动调整，在数量化投资技术与基本面深入研究的结合中谋求基金投资组合在偏离风险及超额收益间的最佳匹配。为控制基金偏离目标指数的风险，本基金力求将基金份额净值增长率与目标指数增长率间的日跟踪误差控制 0.5%。
业绩比较基准	巨潮 100 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	风险和预期收益率接近市场平均水平
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 ( 2016 年 7 月 1 日 — 2016 年 9 月 30 日 )
1. 本期已实现收益	11,248,406.08
2. 本期利润	29,857,935.79
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0371
4. 期末基金资产净值	783,754,471.74
5. 期末基金份额净值	0.983

注：(1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

(2) 本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

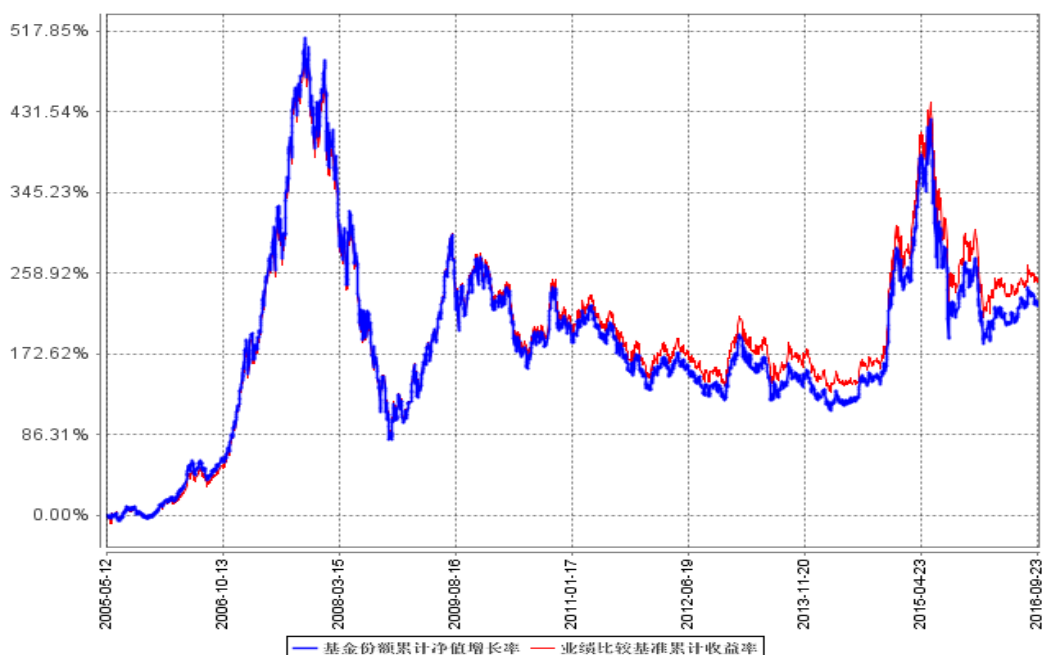
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.80%	0.82%	2.42%	0.73%	1.38%	0.09%

##### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

## 4.1 基金经理 (或基金经理小组) 简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蔡志伟	融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理	2015 年 2 月 11 日	-	4	蔡志伟先生, 华南师范大学计算机硕士、广州大学计算机学士, 金融风险管理师 (FRM), 5 年证券投资从业经历, 具有基金从业资格。曾就职于汇丰软件开发广东有限公司任高级软件工程师 (SSE)。2011 年 6 月加入融通基金管理有限公司, 历任风险管理专员、金融工程研究员, 2015 年 2 月 11 日起至今任“融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF)”基金经理。
李勇	融通深证成份指数证券投资基金、融通创业板指数增强型证券投资基金、融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理	2015 年 1 月 9 日	-	11	李勇先生, 厦门大学经济学硕士、安徽大学数学学士, 11 年证券投资从业经历, 具有基金从业资格。2005 年 1 月入职融通基金管理有限公司, 历任金融工程研究员、基金经理助理职务。2010 年 11 月 15 日起至今任“融通深证成份指数证券投资基金”基金经理, 2012 年 4 月 6 日起至今任“融通创业板指数增强型证券投资基金”基金经理, 2015 年 1 月 9 日起至今任“融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF)”基金经理。

注: 任职日期根据基金管理人对外披露的任职日期填写。证券从业年限以从事证券业务相关的工作时间为计算标准。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内, 本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 在严格控制风险的基础上, 为基金持有人谋求最大利益, 无损害基金持有人利益的行为, 本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

## 4.3 公平交易专项说明

## 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则, 并制定了相应的制度和流程, 在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。报告期内, 本基

金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

#### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

在严格遵守基金合同的前提下实现持有人利益的最大化是本基金管理的核心思想，并将此原则贯彻于基金的运作之中。本基金运用指数化投资方式，通过控制股票投资权重与巨潮 100 指数成份股自然权重的偏离，减少基金相对巨潮 100 指数基金基准的跟踪误差，力求最终实现对巨潮 100 指数基金基准的有效跟踪。

展望 2016 年四季度，全球经济偏弱，中国宏观经济基本面总体偏稳，经济边际改善与结构隐忧并存，仍需进行积极财政政策托底，PPP 项目有望在四季度发力。中国经济在经历了一段时间的下行周期后，目前进入深度去产能阶段，煤炭行业去产能取得一定成效，煤炭价格开始企稳回升；预计四季度经济仍将呈现 L 型底部状态，同时密切关注房地产行业景气度变化，房地产投资运行趋势将对宏观经济走势产生一定影响。在此经济环境下，本基金将积极寻找行业景气度上行，企业基本面向好的优质蓝筹股。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为 3.80%，同期业绩比较基准收益率为 2.42%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	745,315,649.50	94.75
	其中：股票	745,315,649.50	94.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,015,000.00	3.82
	其中：债券	30,015,000.00	3.82
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

7	银行存款和结算备付金合计	10,384,967.29	1.32
8	其他资产	931,900.40	0.12
9	合计	786,647,517.19	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	5,947,532.96	0.76
B	采矿业	13,072,591.27	1.67
C	制造业	181,510,380.14	23.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	87,949.88	0.01
E	建筑业	18,536,596.69	2.37
F	批发和零售业	4,336.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	88,019.36	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,851,466.43	3.68
J	金融业	386,314,570.97	49.29
K	房地产业	38,522,115.66	4.92
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	19,052.82	0.00
S	综合	-	-
	合计	672,954,612.18	85.86

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,806,800.00	0.36
B	采矿业	12,593,868.00	1.61
C	制造业	30,555,250.84	3.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	45,750.11	0.01
F	批发和零售业	32,547.63	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	2,421,158.80	0.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	165,499.52	0.02
J	金融业	15,893,302.42	2.03
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	7,846,860.00	1.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	72,361,037.32	9.23

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	1,556,034	53,154,121.44	6.78
2	601166	兴业银行	2,893,431	46,208,093.07	5.90
3	600036	招商银行	2,086,489	37,556,802.00	4.79
4	600000	浦发银行	1,896,715	31,276,830.35	3.99
5	600519	贵州茅台	98,127	29,233,014.57	3.73
6	000776	广发证券	1,748,938	28,630,115.06	3.65
7	601688	华泰证券	1,548,386	27,793,528.70	3.55
8	601009	南京银行	2,674,628	27,441,683.28	3.50
9	601169	北京银行	3,014,600	27,432,860.00	3.50
10	601988	中国银行	7,208,726	24,293,406.62	3.10

#### 5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002142	宁波银行	1,007,385	15,765,575.25	2.01
2	000983	西山煤电	1,314,600	12,593,868.00	1.61
3	300284	苏交科	329,700	7,846,860.00	1.00
4	300115	长盈精密	250,680	6,966,397.20	0.89
5	600338	西藏珠峰	220,317	6,691,027.29	0.85

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,015,000.00	3.83
	其中：政策性金融债	30,015,000.00	3.83
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债 (可交换债)	-	-

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	30,015,000.00	3.83

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	160401	16 农发 01	300,000	30,015,000.00	3.83

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

##### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 5.11 投资组合报告附注

##### 5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。



### 5.11.2

本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	152,819.72
2	应收证券清算款	211,276.50
3	应收股利	-
4	应收利息	546,953.42
5	应收申购款	20,850.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	931,900.40

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	814,592,289.06
报告期期间基金总申购份额	7,699,256.60
减：报告期期间基金总赎回份额	25,077,581.44
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期末基金份额总额	797,213,964.22

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 设立的文件
- (二) 《融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》

- (三) 《融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》
- (四) 《融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书》及其更新
- (五) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- (六) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

## 8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处、深圳证券交易所

## 8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，或登陆本基金管理人网站  
<http://www.rtfund.com> 查询。

融通基金管理有限公司  
2016 年 10 月 26 日